

## Índice

---

Apresentação.....	2
Alô do Vela.....	4
Introdução .....	6
Advertências do produto:.....	8
O que é um Sistema?.....	10
O que é um Sistema de Trading?.....	12
Por que ter um Sistema de Trading? .....	15
Pensando em probabilidades .....	17
Por que fazer backtest? .....	20
Visão Geral do Processo de desenvolvimento de estratégias de trading .....	22
Formulação da Estratégia.....	25
Quais são os tipos de estratégias? .....	25
Quais são as partes de um sistema? .....	29
Quantidade de regras e graus de liberdade .....	31
Por onde começar?.....	32
Tradução da Estratégia.....	33
Teste Preliminar .....	35
Cuidados e considerações .....	35
Preciso de um software de backtest? .....	35
Preciso de dados?.....	36
Qual a duração do período que devo testar a minha ideia?.....	37
Cheque se o computador está fazendo exatamente o que você quer .....	37
Verifique se não está brincando de vidente.....	38
Dois passos do teste preliminar .....	38
Otimização.....	48
Mas otimizar o que?.....	48
Sinal e barulho (noise).....	49
Como selecionar as variáveis que serão otimizadas? .....	50
Perigos de Overfitting .....	58
Análise de Walkforward .....	59
Avaliação de resultados.....	64
Operando com dinheiro de verdade .....	68
Quando sei se o meu sistema está quebrado? .....	70
Palavras Finais .....	72
Leituras Complementares .....	75